



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报 20170428

联系人: 吕洁

联系人: 邵菁菁

资咨询编号: Z0002739

电话: 0571-28132630

邮箱: lvjie@cindasc.com

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、全国经济体制改革工作会议：推进国企国资改革 加快重点领域混改试点 2、国开行：将提供 1300 亿资金支持雄安新区起步区相关工作 3、默克尔重申退欧谈判底线：英国别幻想温和谈判 4、贸易保护加码！美国调查进口铝 特朗普称铝关乎国家安全				
SHIBOR		4/26/17	4/27/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.178	2.188	1.00	0.46%
	1W	2.476	2.487	1.10	0.44%
	2W	2.595	2.602	0.70	0.27%
	1M	2.740	2.743	0.34	0.12%
	3M	2.802	2.802	0.00	0.00%
CNH HIBOR		4/26/17	4/27/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	1.16	1.32	16.00	13.79%
	1W	1.83	2.75	92.00	50.27%
	2W	2.02	2.85	83.00	41.09%
银行间同业拆借利率		4/26/17	4/27/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.254	2.261	0.66	0.29%
	7D	2.707	2.566	-14.06	-5.19%
	14D	2.835	2.769	-6.60	-2.33%
	1M	3.046	2.894	-15.15	-4.97%
银行间质押回购利率		4/26/17	4/27/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.342	2.310	-3.19	-1.36%
	R007	2.639	2.758	11.96	4.53%
	R014	3.327	3.265	-6.16	-1.85%
	R1M	3.655	3.302	-35.36	-9.67%
上交所质押回购利率		4/26/17	4/27/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	2.625	35.410	3278.50	1248.95%
	GC003	11.845	7.290	-455.50	-38.46%
	GC007	5.000	2.885	-211.50	-42.30%
国债到期收益率		4/26/17	4/27/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.9125	2.9555	0.00	0.00%
	3Y	3.0030	3.0270	1.09	0.46%
	5Y	3.0844	3.0883	-0.57	-0.22%
	7Y	3.2173	3.2235	0.50	0.18%
	10Y	3.2730	3.3102	0.38	0.14%
	20Y	3.7428	3.7477	-0.12	-0.04%
	30Y	3.7506	3.7555	-0.63	-0.20%
票据利率		4/26/17	4/27/17	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴	2.25	2.25	0.00	0.00%
	珠三角	2.40	2.40	0.00	0.00%
	长三角	2.35	2.35	0.00	0.00%
	中西部	2.45	2.45	0.00	0.00%
	环渤海	2.50	2.50	0.00	0.00%

		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
国债期货 行情回顾	TF1706	98.405	21560	8767	0.03%
	TF1709	98.070	4632	708	0.10%
	TF1712	97.670	129	3	0.07%
	T1706	96.095	45591	49300	0.19%
	T1709	95.280	19020	6686	0.25%
	T1712	94.645	1473	108	0.19%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1706	170007.IB	99.0975	2.1247%	0.1316
	TF1709	150026.IB	98.1641	3.4070%	-0.1315
	TF1712	150026.IB	98.1641	2.6945%	0.2792
	T1706	160010.IB	95.4678	2.0276%	0.1223
	T1709	160010.IB	95.4678	0.4896%	0.9119
T1712	160010.IB	95.4678	0.4874%	1.5232	
持仓建议	央行继续在公开市场投放资金,再配合习近平主席关于金融安全是国家安全的重要组成部分,要把防控金融风险放到更加重要的位置的表态看来,本次监管去杠杆并不会出现暴力去杠杆的操作,加上 10 年期国债收益率再触及 3.5%之后再度回落,预计随着配置盘再现,期债或迎来波段性机会,操作上多单择机入场.				
报告中的信息均来源于公开可获得的资料,信达期货有限公司力求准确可靠,但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证,据此投资,责任自负。未经信达期货有限公司授权许可,任何引用、转载以及向第三方传播本报告的行为均可能承担法律责任。					